



Backtest #31538 · VOXR · EVO\_GG1RSISNIP\_v436

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| ROI     | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| -32.73% | -1.13  | 0.0%     | -45.89%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de VOXR con estrategia EVO\_GG1RSISNIP\_v436 revela un rendimiento negativo con ROI de -32.73% y Sharpe ratio de -1.13, indicando que el sistema no generó alfa. Con solo 4 operaciones, la muestra carece de confianza estadística para validar la eficacia del modelo. El 0% de win rate sugiere que todas las señales fueron infructuosas, lo cual podría deberse a una mala selección de activos o parámetros de entrada. La estrategia presenta un riesgo de drawdown máximo de 45.89%, lo cual es inaceptable para una inversión institucional. La próxima acción debe ser un reajuste profundo de los criterios de entrada y salida, incluyendo una validación más robusta con datos históricos.

ADDITIONAL METRICS

|                 |           |
|-----------------|-----------|
| CAGR            | -32.73%   |
| Sortino Ratio   | -0.58     |
| Turnover        | 7.08x     |
| Total Trades    | 4         |
| Initial Capital | \$9997.00 |
| Final Capital   | \$6727.47 |